

國立高雄大學金融管理學系

102 學年度第一學期第一次系課程委員會會議紀錄

會議日期：民國 102 年 11 月 13 日(星期三)中午 12 時 10 分

會議地點：管院306會議室

出席人員：

委員別	姓名	職級	備註
主任委員	張志向	副教授	
校外學界代表	闕河士	教授	
產業界代表	余文彬	會計師	
當然委員	黃一祥	教授	
當然委員	高蘭芬	教授	
當然委員	黃旭輝	教授	
當然委員	陳怡凱	副教授	
當然委員	余歆儀	副教授	產假
當然委員	蔡怡純	副教授	
當然委員	蔡明憲	副教授	
當然委員	楊琬如	助理教授	
當然委員	王文楷	助理教授	
當然委員	王功亮	助理教授	
畢業生代表	蘇芳君	同學	
學生代表	劉芸君	同學	

【備註】委員排序原則：主任委員、校外學界代表、產業界代表、當然委員、畢業生代表及學生代表

主 席：張志向老師

記錄:吳玉婷

壹、主席報告：無

貳、確認 101 學年度第一學期第二次系課程委員會會議紀錄。（附件一， p. 3~4）

參、會議議程：

提案一：有關「102 學年度第二學期新開選修課程」乙案（附件二 p. 3），提請 討論。
說 明：

學制	課程名稱	學分 數	授課教師	上課人 數	備註
碩士班-1、2 年級	計算財務 Computational Finance	3	王文楷老 師	6	p. 5

決議：照案通過。

提案二：檢視「國立高雄大學金融管理學系課程」乙案（附件三，p. 6~p. 8），提請 討論。

說 明：依據本系之核心能力與基本素養檢視本系所屬課程修正與否。

決議：修正後（如附件）通過。

肆：臨時動議：無

伍：散會：13：20

國立高雄大學金融管理學系

一百零一學年度第一學期第二次系課程委員會議紀錄

附件一

會議日期：民國 102 年 01 月 16 日(星期三)中午 12 時整

會議地點：管院306會議室

出席人員：高蘭芬老師、黃旭輝老師、陳怡凱老師、張志向老師、蔡怡純老師、楊琬如老師、

余歆儀老師、蔡明憲老師、王文楷老師、王功亮老師、李佳樺同學、劉芸君同學

請假人員：黃一祥老師、余文彬會計師

主席：高蘭芬老師

記錄：吳玉婷

壹、主席報告：無

貳、確認 101 學年度第一學期第一次系課程委員會會議紀錄。(附件一， p. 3)

參、會議議程：

提案一：有關「101 學年度第二學期新開選修課程」乙案(附件二 p. 4~11)，提請 討論。

說明：

學制	課程名稱	學分數	授課教師	上課人數	備註
大學部-3、4 年級	投資策略理論與實務	3	余歆儀老師	30	p. 4~ p. 6
碩士班-1、2 年級	資產評價	3	余歆儀老師	6	p. 7~ p. 11

決議：照案通過。

提案二：有關「A1001230 謝京陸同學申請雙主修免修課程」乙案(附件三 p. 12~p. 13)，提請 討論。

說明：申請免修課程如附件三 p. 12~p. 13，共計申請免修 15 學分。

決議：除本系專任教師開設之專業必選修課程外，授權該科授課教師決定。

a. 同意：會計學一、二；管理學；行銷管理，小計十二學分；

b. 不同意：經濟學原理一；

提案三：有關「A1003324 許鈺佩同學申請雙主修免修課程」乙案(附件四 p. 14~p. 15)，提請 討論。

說明：申請免修課程如附件四 p. 14~p. 15，共計申請免修 21 學分。

決議：除本系專任教師開設之專業必選修課程外，授權該科授課教師決定。

同意：經濟學原理一、二；會計學一、二；統計學一；管理學；計算機概論，共計21學分

提案四：檢視「國立高雄大學金融管理學系核心能力」乙案（附件五 p.16～p.19），提請 討論。

說明一：依據 101 年 11 月 21 日本系自我評鑑時委員建議：

1. 針對碩士班與大學部的基本核心能力增列細部說明(p.16)。
2. 檢視校、院級與本系的核心能力關聯度(p.17)。

說明二：檢視本系核心能力與課程的關聯度(p.18～p.19)。

說明三：依據余文彬委員建議：課程可增加（一）信託介紹之相關課程；（二）財富管理等相關稅務的課程，如遺產、贈與稅等。

決議一：關於自我評鑑委員的建議增列細部說明與核心能力關聯度照案通過；

決議二：針對余文彬委員建議，回應如下：

1. 信託介紹之相關課程，本系於a. 不動產投資管理 b. 證券投資投資分析等課程皆有安排相關介紹，未來會於課程中強化信託相關內容。
2. 財富管理等相關稅務課程，本系也於a. 個人理財 b. 投資學等相關課程中安排相關介紹，未來會於課程中強化財富管理等相關內容。
3. 為強化稅務相關法規等內容課程，將預計邀請相關專業專家、學者蒞臨系上做演講；抑或於本系必修課程「民法概要」中做補強。

肆：臨時動議：無

伍：散會：13：00

課程名稱：計算財務(Computational Finance)

開課年級：碩一、二

授課教師：王文楷

課程大綱：

The Black-Scholes model and binomial pricing model have been widely used for some purposes in real life such as pricing and hedging derivatives. This module gives students a deeper understanding of the advantages and deficiencies of the models by looking into the mathematical theories and assumptions used in them such as the concept of dynamic hedge and the Black-Scholes assumption. In addition, to price and dynamically hedge a derivative, some numerical methods and programming skills are required. This module will also introduce some numerical methods in finance and help students to develop programming skills in VBA.

課程內容：

The module consists of the following topics:

1. Introduction to Measure Theory
2. Itô's Lemma and Simulation of Stochastic Differential Equations
3. The Binomial Pricing Model
4. The Black-Scholes Model
5. The Monte-Carlo simulation
6. Finite Difference Methods

教科書：

Lecture notes will be distributed in class.

參考書籍與資料：

1. Hull, J. C. (2011). Options, Futures and Other Derivatives (8th Edition). Prentice Hall.
2. Pliska, S. R. (1997). Introduction to Mathematical Finance – Discrete Time Models. Blackwell.
3. Seydel, R. (2012). Tools for Computational Finance (5th Edition). Springer.
4. Wilmott, P. (2007). Introduces Quantitative Finance (2nd Edition). Wiley.
5. 張大成 (2010). 財務工程軟體應用 - Excel VBA 入門與在財務工程的應用. 雙葉書廊.
6. 董夢雲 (2005). 財務工程與 Excel VBA 的應用 - 選擇權評價理論之實作. 證基會出版.

評分方式：

1. Assignments: 20%
2. Midterm Exam: 40%
3. Computer Project: 40%

各級基本素養、核心能力比較：

	校級	院級	系級
基本素養	人文素養、 公民素養、 倫理素養、 科學素養、 專業素養。	1. 社會關懷及世界公民責任。 2. 人文素養與專業學理。 3. 當代思維與國際視野。	(一) 廣博進取。 (二) 誠信正直。 (三) 仁愛良善。 (四) 多元思考，發展創意。
核心能力	知識力、 社會力、 品格力、 創造力。	1. 資訊運用的知識力與判斷力。 2. 職場需求為導向的專業能力。 3. 與國際接軌提昇語文的能力。 4. 創新思維與主動學習的能力。 5. 以科學方法解決問題的能力。	(一) 數理邏輯與經濟分析的能力。 (二) 搜集及解讀會計資訊的能力。 (三) 個人及企業理財的能力。 (四) 投資直接及間接金融市場的能力。 (五) 金融創新及風險控管的能力。 (六) 金融倫理及服務的能力。 (七) 國際化資訊應用的能力。

配合以上七項能力，大學部課程分為三大類：(1) 金融管理的基礎，(2) 金融管理的應用，(3) 金融管理的進階。在各大類之中，又針對課程內容分為數個細項。細分如下：

課程分類		金融管理學系課程名稱
A. 金融管理的基礎	A.1 數理邏輯與經濟分析	經濟學原理(一)、統計學(一)、個體經濟學(一)、經濟學原理(二)、微積分(一)、總體經濟學、微積分(二)、統計學(二)、個體經濟學(二)、貨幣銀行學
	A.2 會計資訊	會計學原理(一)、中級會計學(一)、會計學原理(二)、中級會計學(二) →財務報表
	A.3 基礎能力培養	計算機概論(一)、計算機概論(二)、管理學、管理數學、行銷管理
	A.4 法律與倫理	民法概要、金融倫理、支付及信用工具法[票據法](法律學系、財經法律學系)、證券交易法(財經法律學系)、商事法總論及公司法(法律學系、財經法律學系)、商事法實例演習(法律學系、財經法律學系)
B. 金融管理的應用	B.1 投資專業	企業評價、企業評價與分析、不動產投資管理、金融市場與機構、固定收益型證券、投資學、投資組合管理、基金投資與管理、證券投資分析、公司治理、行為財務
	B.2 理財能力	財務管理(一)、財務管理(二)、個人理財
	B.3 經濟分析應用	計量經濟學
	B.4 會計資訊應用	財務報表分析
C. 金融管理的進階	C.1 金融創新	期貨與選擇權、複利數學、 金融商品定價與投資組合財務工程(一) 、財務工程(二)、衍生性金融商品簡介、選擇權計價理論簡介
	C.2 風險管理	金融風險管理
	C.3 個案與專題	財務管理個案研究、公司理財、金融機構專題
	C.4 國際資訊	投資與財務規劃、國際財務管理 →英文財金書報選讀

研究所課程亦分為三大類：(1) 金融管理的基礎，(2) 金融管理的應用，(3) 金融管理的進階。在各大類之中，又針對課程內容分為數個細項。詳情如下：

課程分類		金融管理學系課程名稱
A. 金融 管理的基 礎	A.1 數理邏輯	計量經濟學
	A.2 會計資訊	財務報表分析
	A.3 基礎能力培養	期貨與選擇權、金融市場
	A.4 法律與倫理	金融倫理
B. 金融 管理的應 用	B.1 投資專業	行為財務、投資組合研究、投資學、資產評價
	B.2 理財能力	公司理財、財務實證研究
	B.3 經濟分析應用	財務研究方法
	B.4 會計資訊應用	會計實證研究
C. 金融 管理的進 階	C.1 金融創新	實質選擇權、複利數學、期貨與選擇權、財務工程、計算財務
	C.2 風險管理	金融機構管理、金融風險管理
	C.3 個案與專題	不對稱訊息之金融市場、財務專題研討(一)、財務專題研討(二)、財務專題研討(三)、財務專題研討(四)
	C.4 國際資訊	國際財務管理